

ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (abril/maio/junho) - 2019

		% Médio Clientes Ganhadores Por Dia	% Médio Clientes Perdedores Por Dia	Ganho Diário Mediano (R\$)	Perda Diária Mediana (R\$)	% Médio Clientes Ganhadores Por Mês	% Médio Clientes Perdedores Por Mês	Ganho Mensal Mediano (R\$)	Perda Mensal Mediana (R\$)
Ações do Ibovespa									
ABEV3		55%	45%	15,7	-12,1	53%	47%	18,9	-19,9
AZUL4		61%	39%	70,7	-51,5	58%	42%	88,6	-73,7
B3SA3		61%	39%	56,4	-50,4	57%	43%	62,4	-54,5
BBAS3		59%	41%	104,9	-79,4	56%	44%	116,3	-84,6
BBDC3		62%	38%	49,4	-48,3	64%	36%	75,5	-39,4
BBDC4		60%	40%	72,8	-61,3	59%	41%	101,3	-61,2
BBSE3		62%	38%	40,0	-26,8	58%	42%	55,5	-36,9
BRAP4		61%	39%	82,9	-66,2	60%	40%	122,7	-86,0
BRDT3		63%	37%	81,3	-63,3	60%	40%	101,0	-58,9
BRFS3		58%	42%	94,0	-72,9	55%	45%	130,3	-93,7
BRKM5		56%	44%	97,9	-103,5	52%	48%	126,7	-112,1
BRML3		60%	40%	42,5	-27,0	57%	43%	52,1	-30,2
BTOW3		57%	43%	122,8	-102,6	59%	41%	170,5	-114,9
CCRO3		60%	40%	58,6	-30,5	57%	43%	58,1	-33,6
CIEL3		56%	44%	58,4	-45,0	53%	47%	51,7	-38,4
CMIG4		61%	39%	64,6	-46,6	57%	43%	62,2	-46,9
CSAN3		61%	39%	78,3	-61,6	57%	43%	103,4	-72,4
CSNA3		55%	45%	78,0	-68,4	52%	48%	86,0	-86,7
CVCB3		59%	41%	67,7	-73,9	61%	39%	103,2	-63,1
CYRE3		63%	37%	49,4	-31,7	59%	41%	61,5	-31,3
ECOR3		63%	37%	38,7	-28,4	59%	41%	39,1	-20,4
EGIE3		63%	37%	34,6	-28,9	58%	42%	33,6	-41,6
ELET3		62%	38%	130,1	-103,6	61%	39%	158,4	-113,9
ELET6		61%	39%	117,6	-81,2	61%	39%	145,2	-98,5
EMBR3		63%	37%	35,9	-31,9	57%	43%	45,2	-29,8
ENBR3		59%	41%	24,3	-21,3	54%	46%	26,1	-22,2
EQTL3		70%	30%	82,2	-47,4	65%	35%	161,0	-74,6
ESTC3		61%	39%	68,0	-53,5	56%	44%	79,1	-59,2
FLRY3		62%	38%	18,6	-16,4	60%	40%	19,6	-12,1
GGBR4		60%	40%	83,4	-50,6	56%	44%	88,0	-45,4
GOAU4		60%	40%	55,7	-32,5	56%	44%	71,5	-28,8
GOLL4		57%	43%	105,5	-94,1	54%	46%	119,7	-99,3
HYPE3		59%	41%	36,1	-36,7	55%	45%	53,6	-45,2
IGTA3		61%	39%	68,8	-52,5	62%	38%	112,0	-57,6
IRBR3		65%	35%	109,6	-78,1	61%	39%	164,8	-99,2
ITSA4		62%	38%	20,4	-12,2	58%	42%	17,8	-11,5
ITUB4		58%	42%	52,9	-41,5	54%	46%	56,2	-46,6
JBSS3		59%	41%	79,1	-71,5	59%	41%	103,4	-85,9
KLBN11		62%	38%	54,9	-27,4	59%	41%	70,8	-38,7
KROT3		62%	38%	62,9	-50,5	61%	39%	78,3	-47,4
LAME4		59%	41%	41,3	-26,2	57%	43%	41,8	-28,6
LREN3		65%	35%	74,5	-52,6	64%	36%	100,5	-50,7
MGLU3		60%	40%	188,9	-196,8	59%	41%	190,2	-203,2
MRFG3		56%	44%	34,7	-31,2	53%	47%	41,8	-36,2
MRVE3		63%	37%	24,5	-17,2	64%	36%	32,9	-23,7
MULT3		62%	38%	61,9	-41,6	59%	41%	74,6	-56,4
NATU3		60%	40%	76,0	-76,4	57%	43%	119,2	-104,2
PCAR4		65%	35%	101,1	-82,6	61%	39%	133,5	-104,8
PETR3		61%	39%	68,3	-49,7	59%	41%	88,9	-57,5
PETR4		58%	42%	68,3	-56,5	55%	45%	60,8	-60,5
QUAL3		62%	38%	46,8	-29,9	60%	40%	49,7	-27,5
RADL3		64%	36%	73,7	-73,1	61%	39%	106,9	-94,9
RAIL3		62%	38%	56,6	-39,6	58%	42%	63,1	-40,9
RENT3		64%	36%	77,0	-55,8	62%	38%	83,0	-50,5
SANB11		63%	37%	62,4	-58,8	59%	41%	100,4	-70,9
SBSF3		62%	38%	83,5	-79,7	59%	41%	110,8	-143,4
SMLS3		66%	34%	89,3	-72,3	66%	34%	179,3	-94,7
SUZB3		58%	42%	103,4	-92,1	56%	44%	111,0	-102,8
TAEI11		67%	33%	31,1	-19,6	62%	38%	37,1	-15,2
TIMP3		66%	34%	31,2	-19,3	60%	40%	39,6	-17,4
UGPA3		63%	37%	74,1	-70,4	60%	40%	115,9	-81,7
USIM5		57%	43%	61,6	-42,1	56%	44%	70,0	-49,5
VALE3		57%	43%	89,6	-76,3	52%	48%	97,9	-95,0
VIVT4		66%	34%	39,0	-33,9	63%	37%	66,0	-39,8
VVAR3		55%	45%	52,3	-27,7	54%	46%	59,3	-24,3
WEGE3		69%	31%	21,9	-14,3	64%	36%	22,9	-11,6
ETF									
BOVA11		58%	42%	28,1	-18,9	55%	45%	34,0	-14,4
BOVV11		83%	17%	20,2	-19,1	66%	34%	115,3	-9,6
Futuros									
WDO		Vencimentos							
	1º vencimento	50%	50%	72,0	-94,8	26%	74%	129,8	-223,4
	WIN	54%	46%	77,3	-104,7	28%	72%	210,1	-295,7
Opções de Compra									
		Intervalo de Delta (%)							
BBAS3	0 ≤ Δ ≤ 20	55%	45%	37,0	-14,2	53%	47%	62,1	-45,0
BBAS3	20 ≤ Δ ≤ 40	63%	37%	71,9	-83,4	58%	42%	89,7	-79,7
BBAS3	40 ≤ Δ ≤ 60	68%	32%	149,6	-91,9	66%	34%	119,5	-99,5
BBAS3	60 ≤ Δ ≤ 80	71%	29%	139,7	-75,0	69%	31%	119,5	-50,2
BBAS3	80 ≤ Δ ≤ 100	64%	36%	19,1	-13,3	67%	33%	47,4	-5,6
BBDC4	0 ≤ Δ ≤ 20	58%	42%	7,5	-21,1	60%	40%	21,1	-30,0
BBDC4	20 ≤ Δ ≤ 40	64%	36%	68,8	-44,9	69%	31%	59,9	-51,0
BBDC4	40 ≤ Δ ≤ 60	75%	25%	94,2	-88,6	72%	28%	94,6	-125,7
BBDC4	60 ≤ Δ ≤ 80	70%	30%	139,9	-60,3	67%	33%	129,4	-30,2
BBDC4	80 ≤ Δ ≤ 100	88%	12%	55,3	-11,0	80%	20%	20,7	-11,0

ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (abril/maio/junho) - 2019

Opções de Compra	Intervalo de Delta (%)	% Médio Clientes	% Médio Clientes	Ganho	Perda	% Médio Clientes	% Médio Clientes	Ganho	Perda
		Ganhadores Por Dia	Perdedores Por Dia	Diário Mediano (R\$)	Diária Mediana (R\$)	Ganhadores Por Mês	Perdedores Por Mês	Mensal Mediano (R\$)	Mensal Mediana (R\$)
CSNA3	0 ≤ Δ ≤ 20	50%	50%	20,8	-11,0	44%	56%	22,5	-30,0
CSNA3	20 ≤ Δ ≤ 40	47%	53%	29,7	-32,6	45%	55%	40,4	-40,1
CSNA3	40 ≤ Δ ≤ 60	52%	48%	69,9	-41,1	60%	40%	59,9	-48,1
CSNA3	60 ≤ Δ ≤ 80	58%	42%	58,0	-51,5	69%	31%	68,2	-52,1
CSNA3	80 ≤ Δ ≤ 100	70%	30%	29,9	-187,5	62%	38%	17,9	-31,8
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	45%	55%	159,7	-8,2	42%	58%	159,8	-96,3
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	56%	44%	139,0	-80,3	58%	42%	199,7	-101,1
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	60%	40%	178,0	-140,9	64%	36%	238,8	-153,3
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	62%	38%	169,2	-126,5	68%	32%	269,4	-172,4
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	59%	41%	83,9	-66,7	59%	41%	219,6	-148,4
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	52%	48%	80,3	-41,6	49%	51%	139,3	-116,2
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	57%	43%	170,8	-134,5	58%	42%	249,1	-181,6
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	61%	39%	161,8	-166,3	64%	36%	259,3	-160,5
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	67%	33%	152,6	-197,5	66%	34%	272,4	-205,4
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	73%	27%	109,8	-84,9	62%	38%	248,4	-216,3
Opções de Venda	Intervalo de Delta (%)								
BBAS3	0 ≤ Δ ≤ 20	47%	53%	23,0	-30,0	57%	43%	37,4	-25,0
BBAS3	20 ≤ Δ ≤ 40	51%	49%	99,7	-70,3	53%	47%	114,4	-59,2
BBAS3	40 ≤ Δ ≤ 60	66%	34%	94,2	-55,3	71%	29%	181,5	-73,5
BBAS3	60 ≤ Δ ≤ 80	81%	19%	399,6	-153,7	81%	19%	325,7	-145,5
BBAS3	80 ≤ Δ ≤ 100	58%	42%	89,9	-7,1	49%	51%	64,5	-21,6
BBDC4	0 ≤ Δ ≤ 20	47%	53%	18,0	-10,0	43%	57%	99,0	-6,0
BBDC4	20 ≤ Δ ≤ 40	58%	42%	103,9	-23,0	52%	48%	153,7	-46,1
BBDC4	40 ≤ Δ ≤ 60	75%	25%	139,4	-35,1	72%	28%	230,0	-66,0
BBDC4	60 ≤ Δ ≤ 80	71%	29%	210,8	-38,1	57%	43%	110,0	-30,1
BBDC4	80 ≤ Δ ≤ 100	100%	0%	31,9		100%	0%	31,9	
CSNA3	0 ≤ Δ ≤ 20	53%	47%	24,0	-15,5	50%	50%	37,5	-10,0
CSNA3	20 ≤ Δ ≤ 40	52%	48%	39,9	-29,0	54%	46%	65,0	-27,4
CSNA3	40 ≤ Δ ≤ 60	64%	36%	59,9	-30,1	75%	25%	79,9	-26,0
CSNA3	60 ≤ Δ ≤ 80	75%	25%	59,6	-41,4	70%	30%	99,8	-51,0
CSNA3	80 ≤ Δ ≤ 100	75%	25%	283,2	-525,5	75%	25%	283,2	-525,5
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	46%	54%	87,6	-20,0	44%	56%	99,7	-60,1
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	53%	47%	118,8	-78,4	52%	48%	149,7	-100,9
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	58%	42%	122,9	-80,2	63%	37%	186,3	-100,3
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	62%	38%	120,8	-96,1	68%	32%	218,7	-100,3
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	59%	41%	56,8	-25,3	63%	37%	278,8	-87,7
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	51%	49%	97,6	-45,1	49%	51%	116,7	-130,0
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	58%	42%	141,1	-114,2	60%	40%	226,7	-120,2
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	64%	36%	176,6	-189,6	68%	32%	205,2	-151,6
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	62%	38%	199,5	-242,4	68%	32%	229,2	-57,4
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	61%	39%	135,7	-141,1	72%	28%	244,5	-184,8

	MÉTRICAS DE RISCO		
	VaR 1d (99,96%)	Estresse Estatístico (99,96%)	Estresse Estatístico (0,04%)
Ações do Ibovespa			
ABEV3	4,9%	11,1%	-9,5%
AZUL4	7,6%	13,4%	-13,1%
B3SA3	9,2%	20,9%	-16,7%
BBAS3	5,4%	17,2%	-13,6%
BBDC3	4,6%	13,3%	-11,2%
BBDC4	4,2%	13,0%	-10,7%
BBSE3	4,3%	10,1%	-8,8%
BRAP4	6,8%	17,5%	-14,6%
BRDT3	7,4%	15,6%	-11,6%
BRFS3	10,5%	15,5%	-12,6%
BRKM5	10,9%	18,5%	-14,1%
BRML3	6,0%	20,6%	-15,0%
BTOW3	9,0%	24,4%	-18,1%
CCRO3	5,7%	17,4%	-14,2%
CIEL3	9,1%	12,0%	-10,8%
CMIG4	6,0%	15,0%	-12,8%
CSAN3	6,4%	18,6%	-15,9%
CSNA3	9,7%	21,2%	-16,3%
CVCB3	7,2%	12,2%	-9,8%
CYRE3	7,4%	29,0%	-20,8%
ECOR3	6,2%	12,4%	-10,6%
EGIE3	4,6%	18,7%	-14,7%
ELET3	7,6%	21,1%	-15,7%
ELET6	6,2%	18,4%	-14,2%
EMBR3	4,9%	15,5%	-12,9%
ENBR3	6,2%	32,0%	-23,2%
EQTL3	4,8%	12,1%	-10,5%
ESTC3	7,6%	21,4%	-17,5%
FLRY3	4,3%	11,0%	-9,2%
GGBR4	5,9%	15,4%	-12,6%
GOAU4	6,6%	18,0%	-15,1%
GOLL4	11,6%	30,7%	-19,5%
HYPE3	6,0%	17,0%	-13,5%
IGTA3	5,3%	13,0%	-10,8%
IRBR3	7,0%	8,7%	-6,5%
ITSA4	4,6%	14,0%	-11,3%
ITUB4	4,6%	14,5%	-11,6%
JBSS3	9,9%	23,5%	-17,8%
KLBN11	4,8%	15,0%	-12,2%
KROT3	7,1%	17,2%	-14,3%
LAME4	5,8%	16,9%	-13,2%
LREN3	5,1%	17,2%	-13,0%
MGLU3	7,1%	30,8%	-20,6%
MRFG3	7,2%	23,5%	-17,1%
MRVE3	7,7%	21,7%	-17,6%
MULT3	6,3%	16,1%	-13,0%
NATU3	8,3%	13,4%	-10,7%
PCAR4	9,6%	12,4%	-10,7%
PETR3	5,5%	18,6%	-15,8%
PETR4	5,3%	17,9%	-16,0%
QUAL3	6,0%	16,8%	-14,5%
RADL3	5,5%	27,1%	-18,1%
RAIL3	5,8%	25,9%	-20,5%
RENT3	5,0%	18,1%	-13,8%
SANB11	4,8%	11,1%	-9,7%
SBSP3	8,0%	13,8%	-12,4%
SMLS3	6,8%	21,1%	-18,6%
SUZB3	8,5%	14,4%	-11,7%
TAEI11	3,6%	18,3%	-14,5%
TIMP3	5,9%	20,9%	-16,4%
UGPA3	7,0%	12,5%	-10,5%
USIM5	7,3%	21,4%	-16,5%
VALE3	7,1%	17,2%	-14,6%
VIVT4	3,6%	9,5%	-8,3%
VVAR3	12,1%	22,7%	-16,6%
WEGE3	4,1%	20,4%	-15,7%
ETFs			
BOVA11	3,6%	8,3%	-7,6%
BOVV11	3,6%	7,0%	-7,0%
Spots			
DOL	2,2%	7,9%	-6,4%
IND	3,6%	9,8%	-9,7%
Curvas (bps)			
Pré 1 ano	17,1	45,9	-38,1
Pré 3 anos	26,2	55,6	-44,1
Pré 5 anos	28,4	77,3	-63,3
Cupom de IPCA 1 ano	24,0	50,7	-41,6
Cupom de IPCA 5 anos	19,0	43,8	-34,4
Cupom de IPCA 10 anos	12,9	70,1	-56,1
Cupom de IPCA 15,5 anos	10,8	75,6	-61,8